

Berechnung CVA



Fonds: 2496T2 Capitulum Weltzins-Invest Universal AK I
 Währung: EUR
 ISIN: DE000A2H7NU1
 LEI: 529900Q626RC55DLB570
 Fondsvermögen: 297.632.212,20
 Anteile in Umlauf: 3.624.726

Auswertung per: 20.5.2026 23:45
 Bewertungsdatum: 20.5.2026 23:45

Kontrahent ID	Kontrahent	Kontrahent-LEI	KSA Bonitätsstufe Kontrahent	Risikogewicht je Kontrahent (RW)	Standard CVA-Risiko SCVA	Term 1 Fonds (Zwischenergebnis)	Term 2 Fonds (Zwischenergebnis)	CVA-Risiko im Rahmen des Basisansatzes - unhedged BACVA	CVA-Risiko im Rahmen des Basisansatzes - total BACVA	total BACVA in % FV	Zielfonds Anzahl Gegenparteien
871001	BNP Paribas S.A.	ROMUWSFPU8MPRO8K5F	2	5,00	6.650,10	1.218.806.891,04	3.026.262.915,98	42.350,23	42.350,23	0,01	0
805250	J.P. Morgan SE	549300ZK53CNGEEI6A29	1	5,00	63.172,73	1.218.806.891,04	3.026.262.915,98	42.350,23	42.350,23	0,01	0
Total								42.350,23	42.350,23	0,01	
									davon OTC:		
									1.889.297,76	0,63	

Fondsvolumen inkl. Forderungen 297.632.212,20
 - Fondsvolumen aus Bewertung 297.632.212,20
 Differenz -0,00

	297.632.212,20	Default: Fondsvolumen aus Bewertung --> mit Buchwert überschreiben
	Betrag in Buchwert:	
	42.350,09	
	1.889.297,85	
	396.949,11	
	15.507.504,37	
ZUSATZINFORMATIONEN:		
CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten	0,01 Zeile 20; Spalte 70	
Betrag Summe der Risikopositionswerte (OTC-Derivate mit CVA-Charge)	0,63 Zeile 20; Spalte 10	
Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteausfallrisiko der OTC-Derivate mit CVA-Relevanz	0,13 Zeile 20; Spalte 20	
Betrag Nominalbetrag CVA-Geschäfte	5,21 Zeile 20; Spalte 30	
Gruppeninterne Geschäft: CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten		
Gruppeninterne Geschäft: CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten	0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 70	
Gruppeninterne Geschäft: Betrag Summe der Risikopositionswerte	0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 10	
Gruppeninterne Geschäft: Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteausfallrisiko	0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 20	
CVA-Risiko Betrag aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften		
Betrag Summe der Risikopositionswerte (Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mit CVA-Charge)	0,00 Zeile 130; Spalte 70	
Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteausfallrisiko der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mit CVA-Relevanz	0,00 Zeile 130; Spalte 10	
	0,00 Zeile 130; Spalte 20	
Aggregation systematischer Komponenten des CVA-Risikos		
Aggregation systematischer Komponenten des CVA-Risikos	0,02 Zeile 230; Spalte 70	
Aggregation spezifischer Komponenten des CVA-Risikos	0,02 Zeile 240; Spalte 70	